

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

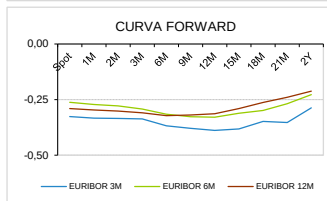
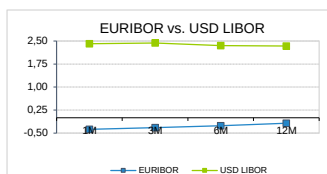
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

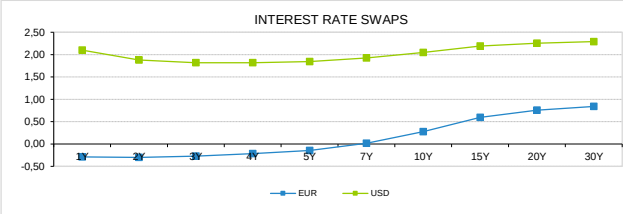
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3770	0	-1	1M	2,4134	0	-4	0,7238	-0,7984
3M	-0,3190	0	-1	3M	2,4358	-1	-9	0,7856	-0,7060
6M	-0,2580	0	-3	6M	2,3488	-2	-24	0,8650	-0,6616
12M	-0,1780	0	-6	12M	2,3376	-1	-36	0,9720	-0,5412

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2900	0	-5	-0,3149	-0,0567	0,3180
2Y	-0,3000	-1	-9	-0,2625	0,0351	0,4190
3Y	-0,2700	-1	-12	-0,1935	0,1286	0,5210
4Y	-0,2160	-2	-14	-0,1127	0,2261	0,6215
5Y	-0,1450	-1	-16	-0,0272	0,3260	0,7030
7Y	0,0170	-1	-18	0,1580	0,5110	0,8481
10Y	0,2770	0	-21	0,4170	0,7183	0,9896
15Y	0,5950	1	-24	0,6982	0,9072	1,0943
20Y	0,7580	1	-24	0,8373	0,9826	1,1050
30Y	0,8400	1	-24	0,8931	0,9776	1,0470

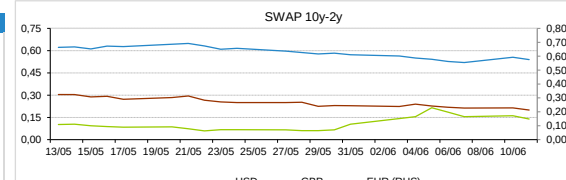
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0990	-2	-43	1,7866	1,8790	2,1225
2Y	1,8790	-1	-51	1,7660	1,9330	2,1805
3Y	1,8180	-1	-50	1,8144	1,9970	2,2250
4Y	1,8180	-2	-48	1,8682	2,0560	2,2888
5Y	1,8440	-3	-46	1,9010	2,1105	2,3305
7Y	1,9250	-3	-43	2,0060	2,1960	2,3660
10Y	2,0470	-3	-40	2,1335	2,2935	2,4190
15Y	2,1900	-2	-37	2,2778	2,3883	2,4530
20Y	2,2560	-2	-36	2,3331	2,3900	2,4731
30Y	2,2910	-2	-34	2,3330	2,3800	2,4100

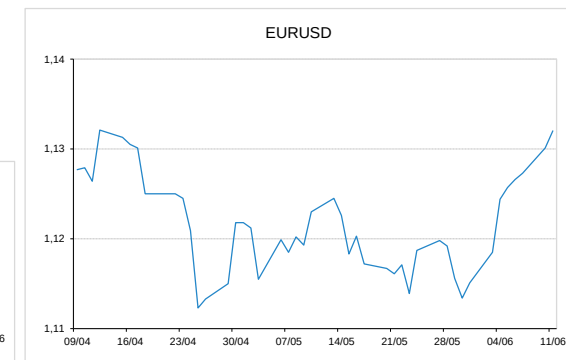
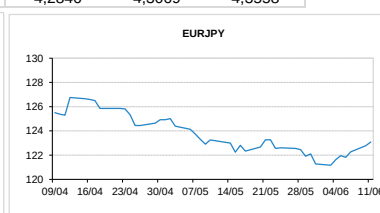


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,36	0,07	-7,28	OT 2Y	-0,321	0,03	1,80
JETFUEL	596,39	1,41	-75,61	OT 5Y	-0,074	0,00	-17,20
DIESEL	563,14	1,16	-77,86	OT 10Y	0,647	-0,04	-47,00
COBRE	5.877,00	75,00	-252,00	BUND 10Y	-0,821	-1,94	-20,60
ZINCO	2.582,00	7,00	-87,50	SCHATZ 2Y	-0,053	-0,23	-6,40
OURO	1.326,61	-0,75	38,54	T-NOTE 10Y	2,907	0,79	-24,80
TRIGO	505,75	-1,75	81,00	T-NOTE 2Y	2,245	3,07	-29,10
LICENÇA C02	24,99	-0,21	-0,63	GILT 10Y	0,851	1,89	-28,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,132	0,17%	0,67%	1,1404	1,1480	1,1631
EUR/GBP	0,89085	0,18%	-3,07%	0,8936	0,8966	0,9029
EUR/JPY	123,09	-0,25%	-0,02%	123,09	123,09	123,09
EUR/CHF	1,1230	-0,30%	0,63%	1,1219	1,1208	1,1186
EUR/BRL	4,3665	0,74%	2,63%	4,4339	4,4962	4,6166
EUR/PLN	4,2638	-0,03%	1,04%	4,2846	4,3069	4,3558



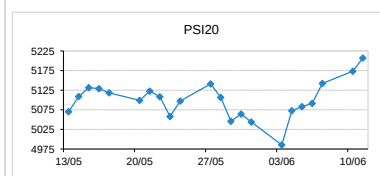
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1320	0,8909	123,09	1,1230	10,6861	7,4684	1,5057	1,62726	4,3665	9,7714
USD	0,8838	-	0,7863	108,585	0,9926	9,4479	6,6008	1,3283	1,4377	3,8634	8,6347

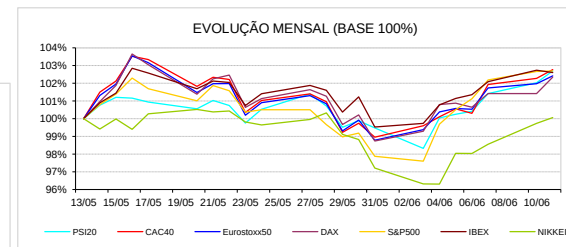
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,100	0,91	5,17
BCP	0,262	1,71	14,29
CORT. AMORIM	10,160	-0,20	12,89
CTT	2,302	0,44	-21,86
EDP	3,448	0,06	13,09
EDP R	9,100	0,00	17,04
GALP	13,795	0,69	0,00
IBERSOL	8,000	1,78	1,27
J MARTINS	14,580	-0,17	41,01
MOTA ENGIL	1,954	0,00	21,37
NAVIGATOR	3,298	2,68	-8,39
NOS	5,810	0,87	9,73
NOVABASE	2,270	0,89	12,38
PHAROL	0,154	2,89	-5,51
RAMADA	7,380	0,00	-1,60
REN	12,520	1,95	-4,43
SEMAPA	0,780	-1,02	-8,13
SONAE CAP.	0,909	0,22	12,16
SONAE SGPS	7,380	0,00	-1,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	2,94
NAVIGATOR	2,68
REN	1,95
IBERSOL	1,78
BCP	1,71
J MARTINS	-0,17
CORT. AMORIM	-0,20
SEMAPA	-1,02



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.207,15	0,65%	10,05%	5.701,90	4.551,84
CAC40	5.408,45	0,48%	14,33%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.401,10	0,43%	13,32%	3.540,64	2.908,70
XTRA DAX	12.155,81	0,92%	15,12%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.889,45	0,03%	15,19%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.282,10	-0,13%	8,69%	9.985,90	8.286,20
NIKKEI 225	21.204,28	0,33%	5,94%	24.448,07	18.948,58



A informação mencionada é meramente indicativa e reflecte o mercado pelas 16h30. As opiniões emitidas não podem ser entendidas como conselho ou recomendação para a prática de qualquer acto. A informação foi recolhida de fontes consideradas fiáveis, não se responsabilizando, no entanto, o CaixaBI por quaisquer incorrecções que as mesmas possam conter. Para mais informações, contactar a Sala de Mercados (Assessoria e Gestão de Risco a Empresas) do CaixaBI.

2017 © Caixa - Banco de Investimento, SA. Todos os direitos reservados.

O Caixa - Banco de Investimento, S.A. é membro da Euronext e é um intermediário financeiro registado na CMVM com o número 102.